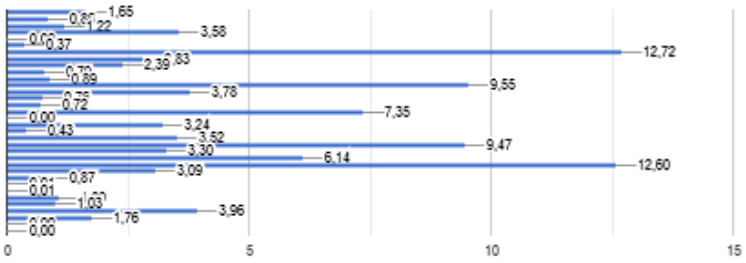
Relatório Risco da Carteira

RPPS	FARROUPILHA	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,20%	4.254.204,72
15.570.431/0001-60	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 - PF NAJU	7,45%	5,82%	2.215.344,12
19.882.420/0001-77	BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,29%	2,26%	3.148.120,00
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,90%	1,14%	9.192.352,31
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,90%	1,13%	0,00
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	9,90%	7,64%	962.660,07
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,26%	32.703.226,40
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,37%	7.274.231,08
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,15%	6.140.597,62
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,82%	1,25%	2.025.497,77
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,81%	3,98%	2.295.675,34
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	2,58%	24.542.960,67
14.091.645/0001-91	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,92%	1,52%	9.726.195,42
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	0,19%	1.960.471,70
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	1,41%	1.862.297,02
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,05%	18.893.090,82
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,76%	8.327.227,76
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,76%	1.116.888,43
19.768.682/0001-05	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,08%	2,61%	9.060.204,00
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13%	0,08%	24.356.645,70
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,48%	1,22%	8.487.480,15
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	1,24%	15.789.416,36
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	1,24%	32.398.007,36
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,16%	2,57%	7.953.002,07
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	0,19%	2.242.356,88
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,06%	2,18%	32.632,90
13.767.159/0001-88	CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	6,20%	55,29%	21.302,46
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,15%	6,10%	2.796.623,56
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,75%	8,20%	2.652.109,52
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	10,66%	8,58%	10.171.035,00
14.507.699/0001-95	CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	11,95%	9,40%	4.513.647,04
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,26%	0,19%	0,00
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,43%	1,51%	0,00
			Total:	**R$ 257.115.504,25**

VAR (95%): O VaR indica a perda percentual máxima esperada para um ativo ou portfólio de investimentos, dado um prazo, com um certo nível de confiança. Por exemplo, se o VaR de 1 dia de um fundo é de 4%, com um nível de confiança 95%, significa que,

estatisticamente, temos 95% de certeza que, se houver uma perda de hoje para amanhã, o prejuízo máximo será de 4%

% ATIVOS vs RISCO



"As informações dos relatórios são obtidas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, onde a responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela empresa. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento. Fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo seguro ou do fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não é garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendado a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos".